



Deutsche Software  
Engineering & Research

## Newsletter

Vielen Dank für Ihr Interesse an unserem Newsletter. Wir informieren Sie in Zukunft über Neuigkeiten, spannende Marktentwicklungen und versorgen Sie mit kurzen Informationen rund um die Wertpapierberatung. Heute informieren wir Sie über:

- ▶ **munio** mit dem MaximumDrawdown Ansatz der aktuellen Wertpapierkrise trotzen!
- ▶ **munio** Risikoüberwachung der Depots

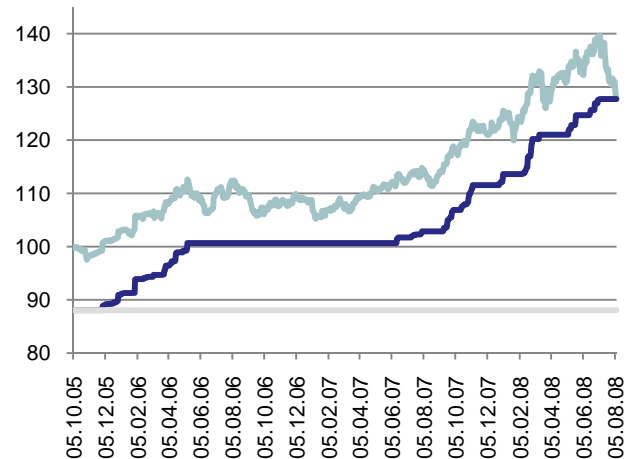
## Der MaximumDrawdown- Ansatz

**munio** optimiert auf Basis echter Wertpapierkursverluste. Die Optimierung beachtet die Wechselwirkung der Verlustrisiken untereinander und setzt die Wertpapiere so zusammen, dass in dem gewünschten Anlagehorizont das Depotverlustrisiko hält.

Die aktuellen Turbulenzen an den Märkten stellen unter Beweis, dass eine Risikooptimierung mit anschließenden Risikokontrolling die einzige echte Vorgehensweise ist den Kunden ein stabiles Portfolio anzubieten.

Ein Stresstest und ein Backtesting zeigen auf, wie stabil das Kundenportfolio ist.

Mit **munio** optimierte Depots sind stabiler als normale Depotzusammensetzungen, weil sie unter Beachtung des Verlustrisikos und der Korrelationen der einzelnen Wertpapiere untereinander zusammengesetzt wurden.



Setzen Sie auf wissenschaftlich fundierte Methoden, um Ihren Kunden stabile Depots anbieten zu können!

## Überwachen Sie die Depots Ihrer Kunden

**Die Lösung:** Nutzen Sie die Überwachungsfunktionen in **munio**. Überwachen Sie jede Nacht die optimierten Depots für die Parameter Risiko, Rendite und Laufzeit. Bei Erreichen dieser Werte werden Sie per Mail benachrichtigt, dass beispielsweise das Risiko überschritten oder eine definierte Rendite erreicht wurde. **munio** informiert Sie sofort und direkt, bei welchem Kunde das Risiko gerissen ist und wo Handlungsbedarf entsteht.

Bei Fragen stehen wir Ihnen gern zur Verfügung.



Deutsche Software  
Engineering & Research GmbH

Melanchthonstraße 19  
02826 Görlitz

Telefon: +49 35 81 / 309 - 250  
Telefax: +49 35 81 / 309 - 259

E-Mail: info@dser.de  
Internet: www.dser.de